

Stichtag	II 2016
Referenz	II 2015

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert*	
	II 2016	II 2015	II 2016	II 2015	II 2016	II 2015
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	2.574	1.132	2.726	1.246	2.608	1.199
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	4.018	3.556	4.607	3.954	4.386	3.762
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Zinsderivate v. Passiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
Überdeckung in %	56,1%	214,2%	69,0%	217,4%	68,2%	213,8%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	II 2016	II 2015	II 2016	I 2015
bis zu sechs Monate	38	10	196	207
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	55	0	173	160
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	40	38	188	176
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	324	55	192	154
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	528	47	391	345
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	26	528	341	447
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	615	20	381	343
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	871	426	1.714	1.417
mehr als 10 Jahre	78	8	443	307

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	II 2016	II 2015
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	81,8%	74,5%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	92,5%	83,0%

§ 28 (1) Nr. 10 PfandBG (nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung) Fremdwährung	Zinsstress-Barwert der Deckungsmassen		Zinsstress-Barwert des Pfandbriefumlaufs		Wechselkurs		Nettobarwert in Fremdwährung		Nettobarwert in EUR	
	II 2016	II 2015	II 2016	II 2015	II 2016	II 2015	II 2016	II 2015	II 2016	II 2015
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

In der Deckung befinden sich keine Derivate.

* Die Berechnung des Risikobarwertes erfolgt auf Basis des dynamischen Verfahrens gem. PfandBarwertV.

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse gem. § 12 PfandBG

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	II 2016	II 2015
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	3.199	2.918
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	373	301
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	269	170
mehr als 10 Mio. €	84	0

nach Nutzungsart (I)	II 2016	II 2015
wohnwirtschaftlich	3.242	2.928
gewerblich	683	461

nach Nutzungsart (II)		Stichtag	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zweifamilien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Bürogebäude	Handels-gebäude	Industrie- gebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertrags- fähige Neubauten sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Land	II 2016	930	1.980	331	150	0	0	533	0	0	0	3.924
	II 2015	800	1.764	365	0	0	0	461	0	0	0	3.389
Summe	II 2016	930	1.980	331	150	0	0	533	0	0	0	3.924
	II 2015	800	1.764	365	0	0	0	461	0	0	0	3.389

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Kennzahlen	II 2016	II 2015
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG		
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	0	0
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG		
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	4,6	4,9
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG		
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	55,6	54,9

Anteil am Gesamtumlauf	II 2016	II 2015
Ordentliche Deckung (nominal)	3.924	3.389

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	II 2016	II 2015
§19 (1) Nr.2 PfandBG	0	0
§19 (1) Nr.3 PfandBG	0	0

§ 28 (1) Nr. 4, 5 und 6 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragenen Forderungen	Ausgleichsforderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 1 PfandBG		Forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 2 PfandBG				Forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 3 PfandBG		Summe	
	II 2016	II 2015	Gesamt		davon gedeckte Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		II 2016	II 2015	II 2016	II 2015
Bundesrepublik Deutschland	0	0	0	0	0	0	75	140	75	140
Europäische Institutionen	0	0	0	0	0	0	19	27	19	27
Summe	0	0	0	0	0	0	94	167	94	167

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG Staat	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag der leistungsgestörten Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	II 2016	II 2015	II 2016	II 2015
keine	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0